



СТОХАСТИЧЕСКАЯ АППРОКСИМАЦИЯ

СТОХАСТИЧЕСКАЯ АППРОКСИМАЦИЯ (от греч. *στοχαστικός* – умеющий отгадывать, проницательный), метод решения широкого класса задач статистич. оценивания, при котором каждое следующее значение статистич. оценки получается в виде поправки к уже построенной оценке, и которая основана лишь на новом наблюдении. С. а. относится к непараметрич. последовательным методам оценивания (см. [Непараметрические методы](#) математич. статистики, [Последовательный анализ](#)). Осн. чертами, обусловившими популярность С. а. в теоретич. и прикладных работах, явились её непараметрич. характер (применимость при весьма скудной информации об объекте наблюдения) и рекуррентность (простота пересчёта оценки при поступлении нового результата наблюдений). С. а. применяется во многих прикладных задачах теории управления, в задачах техники, биологии, медицины. Одна из первых процедур С. а. описана в 1951 амер. статистиками Г. Роббинсом и С. Монро и была связана с [регрессионным анализом](#).

Литература

Лит.: Невельсон М. Б., Хасьминский Р. З. Стохастическая аппроксимация и рекуррентное оценивание. М., 1972.